建信现金添益交易型货币市场基金 2017年年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2018年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信现金添益	
基金主代码	003022	
场内简称	现金添益	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月2日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	19,082,505,770.02份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016年9月22日	
下属分级基金的基金简称:	建信现金添益	建信添益
下属分级基金的场内简称:	-	建信添益
下属分级基金的交易代码:	003022	511660
报告期末下属分级基金的份额总额	18,920,575,557.97份	161,930,212.05份

本基金A级建信现金添益份额面值为1元,H级现金添益份额面值为100元。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险和保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取资产配置策略、个券选择策略、利率策略、资产支持证券投资策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	王婕
	联系电话	010-66228888	021-38676252
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	wang2228@gtjas.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95521
传真		010-66228001	021-38677819

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年		2016年9月2日(基金合同生效日)-2016年12月31日		2015年	
	建信现金添益	建信添益	建信现金添益	建信添益	建信现金添益	建信添益
本期已实现收益	384,671,350.61	524,536,324.58	4,197,076.64	26,343,587.05	-	-
本期利润	384,671,350.61	524,536,324.58	4,197,076.64	26,343,587.05	-	-
本期净值收益率	4.1690%	3.9194%	0.9135%	0.8327%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末基金资产净值	18,920,575,557.97	16,193,021,205.33	2,673,043,799.54	5,436,455,273.18	-	-
期末基金份额净值	1.0000	100.00	1.0000	100.00	-	-

金额单位:人民币元

1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

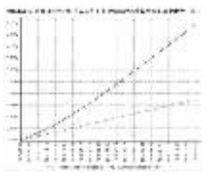
建信现金添益

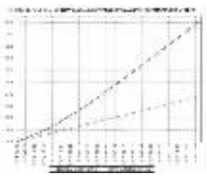
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0876%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.7473%	0.0004%
过去六个月	2.1750%	0.0004%	0.6805%	0.0000%	1.4945%	0.0004%
过去一年	4.1690%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	2.8190%	0.0008%
自基金合同生效起至今	5.1207%	0.0019%	1.7975%	0.0000%	3.3232%	0.0019%

建信添益

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0264%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.6861%	0.0004%
过去六个月	2.0515%	0.0004%	0.6805%	0.0000%	1.3710%	0.0004%
过去一年	3.9194%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	2.5694%	0.0008%
自基金合同生效起至今	4.7848%	0.0019%	1.7975%	0.0000%	2.9873%	0.0019%

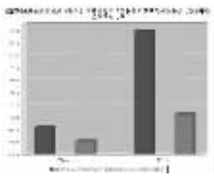
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

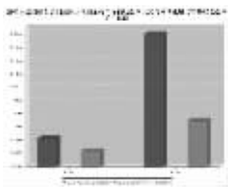




本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





本基金基金合同于2016年9月2日生效,基金成立当年净值收益率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

建信现金添益					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017	384,671,350.61	-	-	384,671,350.61	
2016	4,197,076.64	-	-	4,197,076.64	
合计	388,868,427.25	-	-	388,868,427.25	
建信添益					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017	524,536,324.58	-	-	524,536,324.58	
2016	26,343,587.05	-	-	26,343,587.05	
合计	550,879,911.63	-	-	550,879,911.63	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2017年12月31日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造2025股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金(LOF)基金、建信睿源纯债债券型证券投资基金、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证50交易型开放式指数证券投资基金,共计95只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为3,609.83亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
先柯宇	本基金的基金经理	2017年7月7日	-	5	硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行总行金融市场部工作。历任绩效管理处业务副经理、债券交易员。2016年7月加入我公司。任固定收益投资部基金经理助理。2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理。
陈建良	固定收益投资部副总经理,本基金的基金经理	2016年9月2日	-	10	陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行。任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理,2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理;2016年3月14日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了31458对投资组合,有6807对投资组合未通过T检验,其中3392对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它3415对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,2509对平均溢价率低于2%,其它906对平均溢价率超过2%的投资组合中,有20对投资组合的贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了34512对投资组合,有8794对投资组合未通过T检验,其中3914对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它4880对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,4523对平均溢价率低于5%,其它357对平均溢价率超过5%的投资组合,有5对投资组合贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了35964对投资组合,有10419对投资组合未通过T检验,其中4515对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它5904对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,5809对平均溢价率低于10%,其它95对平均溢价率超过10%的投资组合,有3对投资组合贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年,中国宏观经济增长总体平稳,质量有所提高,结构进一步改善。全年GDP同比增长6.9%,增速较2016年提高了0.2个百分点。拉动经济的三驾马车中,消费整体保持平稳较快增长,全年社会消费品零售总额比上年增长10.2%,其中旅游休闲娱乐消费快速增长,转型升级态势明显;投资方面,全年固定资产投资增速7.2%,结构有一定优化。其中制造业投资增速4.8%,呈现企稳回升态势,基建投资全年增速为19%,仍然保持高位,房地产开发投资全年增速则小幅下滑至7.0%。净出口方面,受益于海外主要经济体的稳健复苏,对外贸易量价齐升,全年货物进出口总额同比增长14.2%,扭转了2016年大幅下降的局面,净出口对于经济贡献也在2017年由负转正。

物价水平上,由于食品价格涨幅回落,2017年全年消费者物价指数(CPI)因春节因素在1月份达到2.5%的全年同比高点之后,基本维持在0.8%至1.9%的窄幅波动,全年同比涨幅1.6%;年初受到国际大宗产品价格上涨和基数影响,工业品价格指数(PPI)同比在2月录得全年高点7.8%,3月份之后涨幅回落并在三季度有所反弹,随后基数原因下四季度再次回落,呈“M”型走势,全年水平为4.9%,较2016年涨幅趋缓。

货币政策方面,2017年货币政策基调维持稳健中性,资金面整体保持紧平衡态势,宏观审慎监管体系进一步完善。央行先后于春节前、3月份,以及12月份类联储加息后上调逆回购和中期借贷便利利率,带动银行间市场资金利率小幅上行,部分时点呈现阶段性紧张局面;此外,金融监管在2017年动作较多,除将表外理财正式纳入广义信贷指标考核外,11月份《关于规范金融机构资产管理业务指导意见(征求意见稿)》颁布,引发金融市场的强烈关注。

债券市场方面,2017年债券市场收益率继续呈现震荡上行态势。一季度由于央行上调公开市场操作利率并实现净回笼,偏紧的流动性环境推动债券收益率曲线陡峭化上行。在经历二、三季度的震荡整理后,四季度随着对于海外债市调整、通胀预期上升以及金融监管再度升级等多重因素的叠加影响,以国开债为代表的利率品收益率进一步大幅上行。整体看,10年期国债和国开债收益率年末收于3.88%和4.82%,较年初分别上行87BP和114BP。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金添益A基金净值收益率4.1690%,波动率0.0008%,现金添益H基金净值收益率3.9194%,波动率0.0008%;业绩比较基准收益率1.3500%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年,此前市场认为供给侧改革导致投资萎缩和需求下滑进而引发基本面明显恶化的逻辑已经证伪,经济有望继续保持韧性,整体增速弹性保持低位,三大需求中,投资或保持稳定,消费则有望接棒出口成为2018年拉动经济增长的主要动能。通胀压力较2017年将有所抬升,在春节错位以及基数作用下,高点或将出现在2月和7月份前后,食品价格和油价将成为重要的决定因素。全年来看,通胀中枢有望上移至2.3%左右,而中性偏紧的货币政策基调下,考虑美联储持续加息导致的全球利率条件收紧,很大程度上将对国内利率水平的下行空间形成制约,高位震荡反复料将成为2018年债券市场的走势常态。

在此环境下,建信现金添益市场基金密切关注权益市场波动对场内流动性的影响,防范流动性风险,保持较高的流动性资产比例。在信用风险的防范上,进一步严格信用准入,适当控制信用债券持仓比例的同时,提升组合资产信用资质水平。同时,进一步延展组合的久期和杠杆弹性,努力在发掘利率中期趋势性价值的基础上,参与短期波段机会把握,获得了较好的投资回报。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金);对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外),本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣,对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金A类基金份额根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付,支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。本基金H类基金份额根据每日基金收益情况,以每百份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,计入投资人收益账户,投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。本报告期内基金应分配利润为909,207,675.19元,其中A类份额应分配利润为384,671,350.61元,H类份额应分配收益为524,536,324.58元,已全部分配,符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,国泰君安证券股份有限公司(以下称“本托管人”)在建信现金添益交易型货币市场基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信现金添益交易型货币市场基金(以下简称“建信现金添益货币基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2018)第22655号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款		18,803,722,107.30	3,300,767,727.41
结算备付金		247,518,234.72	526,410,300.00
存出保证金		190.52	-
交易性金融资产		12,300,683,236.69	1,894,894,106.67
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,300,683,236.69	1,894,894,106.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		6,104,120,351.19	2,356,460,641.13
应收证券清算款		515,541,000.00	-
应收利息		210,503,045.53	20,678,750.99
应收股利		-	-
应收申购款		275,863,136.32	12,684,083.56
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		38,457,951,302.27	8,111,895,609.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		3,327,078,788.11	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,764,808.71	993,072.06
应付托管费		2,484,738.79	317,783.06
应付销售服务费		4,210,331.75	847,800.39
应付交易费用		133,305.89	39,701.20
应交税费		-	-
应付利息		2,106,104.73	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		576,460.99	198,180.33
负债合计		3,344,354,538.97	2,396,537.04
所有者权益:			
实收基金		35,113,596,763.30	8,109,499,072.72
未分配利润		-	-
所有者权益合计		35,113,596,763.30	8,109,499,072.72
负债和所有者权益总计		38,457,951,302.27	8,111,895,609.76

报告截止日2017年12月31日,基金份额总额19,082,505,770.02份,其中建信现金添益交易型货币市场基金A类基金份额净值1.00元,基金份额总额18,920,575,557.97份;建信现金添益交易型货币市场基金H类基金份额净值100.00元,基金份额总额161,930,212.05份。

7.2 利润表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		1,067,402,756.80	39,446,237.72
1.利息收入		1,065,075,022.14	39,707,027.44
其中:存款利息收入		571,919,231.34	19,799,786.35
债券利息收入		356,694,812.07	9,734,456.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		136,460,978.73	10,172,784.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		2,197,733.66	-260,789.72
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,197,733.66	-260,789.72
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		130,000.00	-
减:二、费用		158,195,080.61	8,905,574.03
1.管理人报酬		55,924,379.22	2,852,211.97
2.托管费		17,895,801.22	912,707.82
3.销售服务费		34,178,923.13	2,536,561.93
4.交易费用		-	-
5.利息支出		49,628,127.11	2,360,511.98
其中:卖出回购金融资产支出		49,628,127.11	2,360,511.98
6.其他费用		567,849.93	243,580.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		909,207,675.19	30,540,663.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		909,207,675.19	30,540,663.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,109,499,072.72	-	8,109,499,072.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	909,207,675.19	909,207,675.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	27,004,097,690.58	-	27,004,097,690.58
其中:1.基金申购款	103,179,588,144.24	-	103,179,588,144.24
2.基金赎回款	-76,175,490,453.66	-	-76,175,490,453.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-909,207,675.19	-909,207,675.19
五、期末所有者权益(基金净值)	35,113,596,763.30	-	35,113,596,763.30
项目	上年度可比期间 2016年9月2日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,050,844,765.32	-	4,050,844,765.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	30,540,663.69	30,540,663.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	4,058,654,307.40	-	4,058,654,307.40
其中:1.基金申购款	9,702,930,281.35	-	9,702,930,281.35
2.基金赎回款	-5,644,275,973.95	-	-5,644,275,973.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-30,540,663.69	-30,540,663.69
五、期末所有者权益(基金净值)	8,109,499,072.72	-	8,109,499,072.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____孙志晨_____ _____吴曙明_____ _____丁颖_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信现金添益交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第1446号《关于准予建信现金添益交易型货币市场基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,050,804,687.99元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1124号予以验证。经向中国证监会备案,《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》于2016年9月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,050,844,765.32 份基金份额,其中认购资金利息折合40,077.33份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》和《建信现金添益交易型货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金份额包括建信现金添益货币基金之A类份额(以下简称“建信现金添益A份额”)、建信现金添益货币基金之H类份额(以下简称“建信添益H份额”)。建信现金添益份额只接受场外与场内申购和赎回,建信现金添益A份额不上市交易;建信添益H份额只上市交易。各类基金份额类别分别设置代码并分别计算和公告每万份或每百份基金已实现收益和七日年化收益率。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

建信添益H份额的基金份额折算日为基金合同生效当日,折算前建信添益H份额总额为3,780,763,000.00份,折算前基金份额净值为1.0000元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法,本基金折算后的建信添益H份额总额为37,807,630.00份,折算后基金份额净值为100.00元。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2016]232号文审核同意,本基金H类份额37,807,630.00份于2016年9月21日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在1 年以内(含1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397 天以内(含397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税前)。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2018年3月21日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则–基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金